



Señores
SUPERINTENDENCIA DEL MERCADO DE VALORES
BOLSA DE VALORES DE LIMA

**ASUNTO: HECHO DE IMPORTANCIA -
DERIVADOS**

GF HI-018-2021

Lima, 15 de octubre de 2021

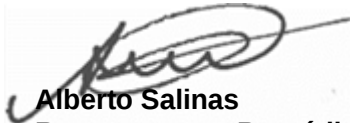
Atención: Registro Público del Mercado de Valores

De nuestra consideración:

De conformidad con lo dispuesto por el artículo 28 del Texto Único Ordenado de la Ley del Mercado de Valores, aprobado por Decreto Supremo No. 93-2002-EF, y por el artículo 3 y Anexo N° 2 del Reglamento de Hechos de Importancia e Información Reservada, aprobado por Resolución SMV No. 005-2014-SMV/01, cumplimos con remitirles la información relacionada con la posición en instrumentos financieros derivados de la empresa al cierre del mes de septiembre de 2021 (con base en los Estados Financieros Trimestrales a junio de 2021).

Sin otro particular, quedamos de ustedes.

Atentamente,



Alberto Salinas
Representante Bursátil

ENGIE Energía Perú S.A.
Av. República de Panamá 3490,
San Isidro, Lima 27 - Perú
T +51 1 616 7979
www.engie-energia.pe



POSICIÓN MENSUAL EN INSTRUMENTOS DERIVADOS

(Numeral 18.1, Anexo 1 del Reglamento de Hechos de Importancia e Información Reservada)

Emisor:	ENGIE Energía Perú S.A.
Al cierre de:	Setiembre 2021 (Con base en los Estados Financieros Trimestrales a junio 2021)

DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Instrumento Derivado ⁽¹⁾	Finalidad ⁽²⁾	Monto Nocional ⁽³⁾	Activo / Pasivo o Variable ⁽⁴⁾	Moneda ⁽⁵⁾	Valor Razonable	
					Mes actual	Mes anterior
Swap de moneda y tasa de interés (Cross currency interest rate swap)	Cobertura	247,904	3er Programa de Bonos Corporativos (1ra, 2da y 3ra emisión, series A y B, con vencimiento en jun26, jun24 jun27 y jun28 respectivamente)	Miles USD	196,031	198,481
Cross currency and interest rate swap	Cobertura	50,000	Préstamos Bancarios	Miles USD	39,103	39,592
Forwards	Cobertura	(d)	Depósitos a Plazo	Miles USD	0	28,867
Forwards	Cobertura	(d)	Cuentas Remuneradas	Miles USD	0	46,745
Forwards	Cobertura	49,292(e)	Préstamos Sintéticos	Miles USD	49,589	0

GANANCIA / PÉRDIDAS ACUMULADAS

	Moneda ⁽⁵⁾	MILES USD
Importe de ganancia / pérdida total acumulada en el año por instrumentos financieros derivados ⁽⁶⁾		-15,004

Información adicional:

- a.- Información expresada en miles de dólares.
- b.- Instrumentos financieros correspondiente a los últimos Estados Financieros Trimestrales publicados (junio 2021), con el valor razonable actualizado a setiembre 2021.
- c.- El tipo de cambio utilizado para los meses de setiembre y agosto de 2021 fue de 4.132 y 4.081 respectivamente soles por dólar que corresponde al tipo de cambio "Compra" publicado por la SBS al 30 de setiembre y 31 de agosto de 2021, respectivamente.
- d.- Al cierre de setiembre, no se contaba con instrumentos financieros derivados en soles, sin embargo, el Monto Nocional al cierre de agosto de los Depósitos a Plazo fue de 30,000 KUSD y de las Cuentas Remuneradas fue de 50,000 KUSD, los cuales vencieron durante el mes de setiembre.
- e. Durante el mes de setiembre se constituyó un nuevo instrumento financiero para un préstamo sintético.

Notas:

- (1) Forward, Futuro, Opción, Swap, entre otras.
- (2) De acuerdo a las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) califican de Cobertura o Negociación.
- (3) Monto nocional o Valor nominal del contrato.
- (4) En caso de derivados de cobertura representa el Activo o Pasivo que se está coberturando y en caso de derivados de negociación es la variable de referencia.
- (5) Moneda de presentación de la información financiera intermedia individual.
- (6) Representa el total de ingresos y/o gastos de **todos** sus instrumentos financieros derivados, lo que incluye: (i) los ingresos y/o gastos por instrumentos derivados acumulados en el año que se registran en el **Estado de Resultados**; y, (ii) el total de variación acumulada al cierre del período de los instrumentos derivados que se registran en **Otros Resultados Integrales**.